

**DEPARTAMENTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO
MUNICÍPIO DE PORTO ALEGRE**

COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO PREVIMPA

ATA Nº 14/2021 - REUNIÃO ORDINÁRIA

Comitê de Investimentos - PREVIMPA

Data e Hora	Local
13/05/2020 - 14 horas	Rua João Manuel, 50 - 10º andar - Sala de Reuniões - PREVIMPA
Participantes	
Rodrigo Machado Costa - Diretor Geral - Previmpa, Daniela Silveira Machado - Diretora Administrativo-Financeira - Previmpa, Dalvin Gabriel José de Souza - Chefe da Unidade de Investimentos - Previmpa, Rogério de Oliveira - Economista - Unidade de Investimentos - Previmpa e Roger Sotoriva Piccini - Administrador - Unidade de Investimentos - Previmpa. Participou também: Renan da Silva Aguiar - Chefe da Assessoria de Planejamento - Previmpa.	
Pauta:	
1 – Informes 2 – Apresentação dos resultados Abril/2021 3 – SEI 21.13.000000760-1 - Parecer Comitê de Investimentos 05/2021 referente a abril de 2021; e 4 – SEI 21.13.000002522-7 - alteração da Política de Investimentos 2021 a 2024.	
Resumo da Reunião	
Formado quórum, Rodrigo abre a mesa de trabalho. Sem informes, passa a palavra a Dalvin para apresentação do Relatório de Resultados dos Investimentos Abril/2021. Dalvin destaca que no último mês a carteira do Capitalizado rendeu 0,98% para uma meta atuarial de 0,75% chegando a um montante de R\$ 3,076 bilhões. No acumulado em 2021, -1,32% de rendimento a 4,19% de meta atuarial. Realizada apresentação, Rodrigo passa para o segundo item da pauta. Referente ao Parecer Comitê de Investimentos 05/2021, fica adiado o debate e deliberação do documento. Na sequência da pauta, Rodrigo passa a palavra para Dalvin. O chefe da Unidade de Investimentos apresenta despacho integrante ao Processo SEI 21.13.000002522-7 que versa sobre alteração da Política de Investimentos 2021/2024, visando a adequação aos limites permitidos no Pró-Gestão e o respectivo nível de governança do PREVIMPA - Nível I, bem como a retificação do Anexo I da referida Política, em relação ao item 22, o qual aborda os investimentos do artigo 9ºA. Feita apresentação e realizado debate, Rodrigo questiona a mesa se há posição contrária. Sem objeções, fica aprovado para encaminhamento ao Conselho de Administração. Sem mais, Rodrigo declara encerrada reunião.	
Encaminhamentos	
1- Aprovação de proposta de alteração da Política de Investimentos 2021-2024 (SEI 21.13.000002522-7)	
Pendências	
1 - Apreciação do Parecer Comitê de Investimentos 05/2021 referente a abril de 2021 (SEI 21.13.000000760-1)	



Documento assinado eletronicamente por **Renan da Silva Aguiar, Administrador(a)**, em 17/05/2021, às 12:43, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Rodrigo Machado Costa, Diretor(a)-Geral**, em 08/06/2021, às 11:13, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Roger Sotoriva Piccini, Servidor Público**, em 08/06/2021, às 11:24, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Daniela Silveira Machado, Diretor Administrativo-Financeiro**, em 08/06/2021, às 17:12, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Dalvin Gabriel José de Souza, Chefe de Unidade**,



em 18/06/2021, às 16:55, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Rogério de Oliveira, Economista**, em 22/07/2021, às 14:11, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



A autenticidade do documento pode ser conferida no site <http://sei.procompa.com.br/autenticidade/seipmpa> informando o código verificador **14099024** e o código CRC **D86D72F3**.

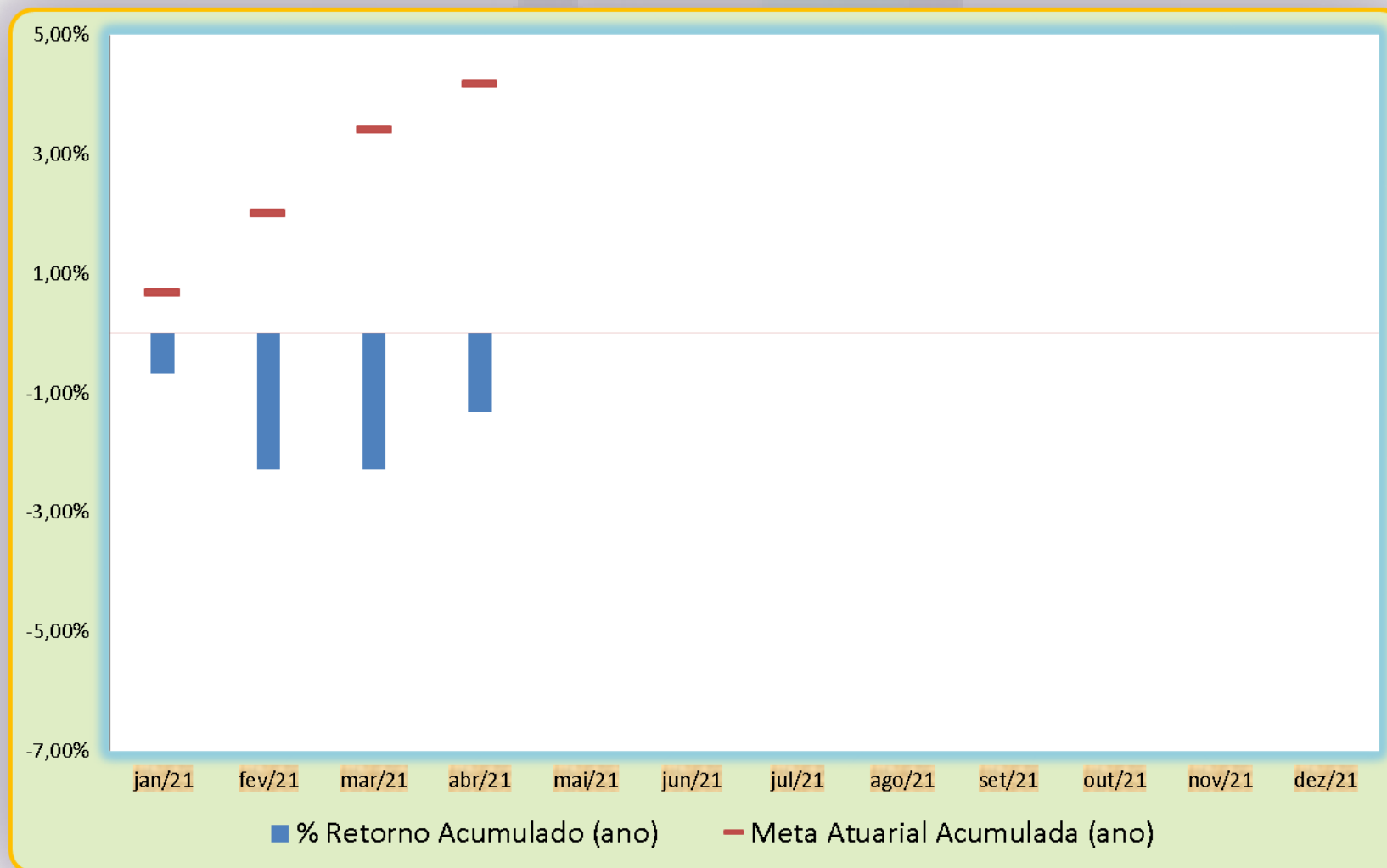
Relatório de Resultados dos Investimentos do PREVIMPA

Competência: Abril/2021

Competência	Patrimônio Líquido Inicial (R\$)	Aplicação (R\$)	Resgate (R\$)	Fluxo de Caixa (R\$)	Fluxo de Caixa Acumulado Anual (R\$)	Patrimônio Líquido Final (R\$)	Retorno Mensal (R\$)	Retorno Acumulado Anual (R\$)	% Retorno Mensal	% Retorno Acumulado (ano)
jan/21	R\$ 3.035.629.264,65	R\$ 125.625.889,51	R\$ 93.233.489,12	R\$ 32.392.400,39	R\$ 32.392.400,39	R\$ 3.046.935.151,30	-R\$ 21.086.513,74	-R\$ 21.086.513,74	-0,6909%	-0,69%
fev/21	R\$ 3.046.935.151,30	R\$ 160.862.699,82	R\$ 144.722.412,08	R\$ 16.140.287,74	R\$ 48.532.688,13	R\$ 3.014.342.224,63	-R\$ 48.733.214,41	-R\$ 69.819.728,15	-1,5952%	-2,28%
mar/21	R\$ 3.014.342.224,63	R\$ 107.715.260,23	R\$ 91.433.667,50	R\$ 16.281.592,73	R\$ 64.814.280,86	R\$ 3.030.110.587,07	-R\$ 513.230,29	-R\$ 70.332.958,44	-0,0170%	-2,29%
abr/21	R\$ 3.030.110.587,07	R\$ 2.275.561.697,61	R\$ 2.259.185.074,20	R\$ 16.376.623,41	R\$ 81.190.904,27	R\$ 3.076.326.853,32	R\$ 29.839.642,84	-R\$ 40.493.315,60	0,9821%	-1,32%
mai/21										
jun/21										
jul/21										
ago/21										
set/21										
out/21										
nov/21										
dez/21										
TOTAL ANO	R\$ 3.035.629.264,65	R\$ 2.669.765.547,17	R\$ 2.588.574.642,90	R\$ 81.190.904,27		R\$ 3.076.326.853,32	-R\$ 40.493.315,60			-1,32%

Indicadores de Performance do Fundo Capitalizado: 2021

Competência	Meta Atuarial (mês)	Meta Atuarial Acumulada (ano)	Retorno Acumulado (12 meses)	Meta Atuarial Acumulada (12 meses)	% Atingido da Meta Atuarial (12 meses)
jan/21	0,69%	0,69%	5,61%	10,78%	51,98%
fev/21	1,31%	2,01%	4,90%	11,41%	42,92%
mar/21	1,38%	3,41%	11,03%	12,32%	89,58%
abr/21	0,75%	4,19%	9,18%	12,97%	70,78%
mai/21					
jun/21					
jul/21					
ago/21					
set/21					
out/21					
nov/21					
dez/21					
		4,19%			



Performance do Fundo Capitalizado – 2010 à 2021

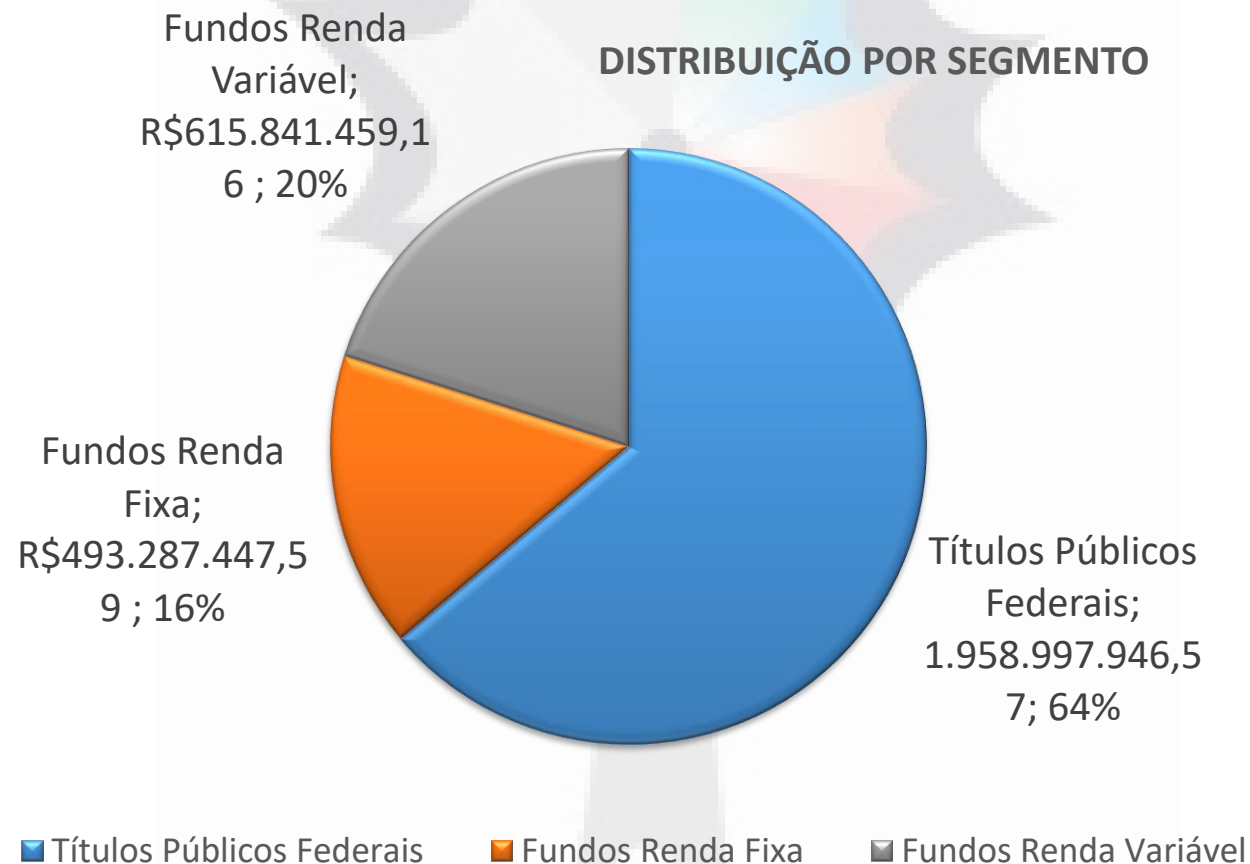
ANO	Patrimônio Líquido Inicial (R\$)	Aplicação (R\$)	Resgate (R\$)	Fluxo de Caixa (R\$)	Patrimônio Líquido Final (R\$)	Retorno Acumulado Anual (R\$)	% Retorno Anual	Meta Anual	IPCA
2021	R\$ 3.035.629.264,65	R\$ 2.669.765.547,17	R\$ 2.588.574.642,90	R\$ 81.190.904,27	R\$ 3.076.326.853,32	-R\$ 40.493.315,60	-1,32%	4,19%	2,37%
2020	R\$ 2.621.348.416,16	R\$ 2.678.972.677,54	R\$ 2.460.817.910,32	R\$ 218.154.767,22	R\$ 3.035.629.264,65	R\$ 196.126.081,27	7,18%	10,79%	4,52%
2019	R\$ 2.066.742.820,09	R\$ 5.098.914.651,21	R\$ 4.901.210.037,97	R\$ 197.704.613,24	R\$ 2.621.348.416,16	R\$ 356.900.982,83	16,48%	10,56%	4,31%
2018	R\$ 1.666.433.054,76	R\$ 4.181.145.254,86	R\$ 3.980.408.901,95	R\$ 200.736.352,91	R\$ 2.067.179.818,46	R\$ 200.010.410,79	11,32%	9,97%	3,75%
2017	R\$ 1.333.235.977,38	R\$ 30.506.885.389,69	R\$ 30.337.743.784,59	R\$ 169.141.605,10	R\$ 1.666.433.054,76	R\$ 164.055.472,28	11,57%	9,12%	2,95%
2016	R\$ 968.655.049,75	R\$ 28.343.626.845,13	R\$ 28.214.966.883,22	R\$ 128.659.961,91	R\$ 1.333.235.977,38	R\$ 235.920.965,72	22,84%	12,67%	6,29%
2015	R\$ 727.153.705,27	R\$ 6.764.020.071,41	R\$ 6.629.567.470,69	R\$ 134.452.600,72	R\$ 968.655.049,75	R\$ 107.048.743,77	13,48%	17,31%	10,67%
2014	R\$ 551.117.589,01	R\$ 781.769.904,64	R\$ 667.849.629,03	R\$ 113.920.275,61	R\$ 727.153.705,27	R\$ 62.115.840,64	10,22%	12,79%	6,41%
2013	R\$ 446.049.829,58	R\$ 132.577.926,35	R\$ 35.998.354,56	R\$ 96.579.571,79	R\$ 551.117.589,01	R\$ 8.488.187,64	1,72%	12,27%	5,91%
2012	R\$ 300.296.104,28	R\$ 138.967.762,11	R\$ 62.076.033,94	R\$ 76.891.728,17	R\$ 446.049.829,58	R\$ 68.861.997,14	20,33%	12,19%	5,84%
2011	R\$ 215.257.115,74	R\$ 189.031.083,64	R\$ 133.161.695,79	R\$ 55.869.387,85	R\$ 300.296.104,28	R\$ 29.169.600,69	11,99%	12,89%	6,50%
2010	R\$ 152.080.762,67	R\$ 87.151.631,72	R\$ 47.265.691,10	R\$ 39.885.940,62	R\$ 215.257.115,74	R\$ 23.290.412,45	13,54%	12,26%	5,91%

Movimentações : Regime Capitalizado

Conta	Títulos Públicos da Carteira Previmpa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
Títulos Públicos Federais		1.934.822.308,77	R\$ 1.079.408.546,36	R\$ 1.073.651.351,73	1.958.997.946,57	R\$ 18.418.443,17	0,95%
Conta	Fundos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
702-5	Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	R\$ 324.519,46	R\$ 1.073.651.351,73	R\$ 1.072.316.411,16	R\$ 1.945.231,08	R\$ 285.771,05	0,03%
702-5	Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	R\$ 340.555.214,04	0,00	R\$ 62.100.000,00	R\$ 281.274.082,83	R\$ 2.818.868,79	0,91%
702-5	FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	R\$ -	17.021.199,86		R\$ 17.196.239,45	R\$ 175.039,59	1,03%
73.339-3	BB Prev RF Fluxo Fc FI	R\$ 284.691,34	R\$ 5.480.599,66	R\$ 1.117.311,31	R\$ 4.648.667,73	R\$ 688,04	0,03%
73.339-3	BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 136.827.105,37		R\$ 50.000.000,00	R\$ 87.460.646,13	R\$ 633.540,76	0,57%
95756.0-2	Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	R\$ 99.868.096,18			R\$ 100.761.332,86	R\$ 893.236,68	0,89%
95756.0-2	Banrisul Automatico FI RF CP	R\$ 1.246,48			R\$ 1.247,51	R\$ 1,03	0,08%
TOTAL DOS FUNDO DE RENDA FIXA		R\$ 577.860.872,87	R\$ 1.096.153.151,25	R\$ 1.185.533.722,47	R\$ 493.287.447,59	R\$ 4.807.145,94	0,90%
TOTAL DA RENDA FIXA		R\$ 2.512.683.181,64	R\$ 2.175.561.697,61	R\$ 2.259.185.074,20	R\$ 2.452.285.394,16	R\$ 23.225.589,11	0,94%

Movimentações: Regime Capitalizado

Conta	Fundos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
40957560-2	It Now Ibov	R\$ 58.515.000,00			R\$ 59.990.000,00	R\$ 1.475.000,00	2,52%
40957560-2	Ishares S&P 500	R\$ 61.085.000,00			R\$ 61.550.000,00	R\$ 465.000,00	0,76%
73.339-3	BB Acoes Retorno Total Fc	R\$ 19.098.819,57			R\$ 20.618.824,63	R\$ 1.520.005,06	7,96%
73.339-3	BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	R\$ 22.530.580,85			R\$ 23.807.288,13	R\$ 1.276.707,28	5,67%
73.339-3	BB Acoes Exportacao Fc FI	R\$ 14.052.663,24			R\$ 15.026.800,87	R\$ 974.137,63	6,93%
73.339-3	BB Acoes Energia FI	R\$ 48.964.938,52			R\$ 48.110.488,03	-R\$ 854.450,49	-1,75%
73.339-3	BB Acoes Nordea GI Cli And Env Ie FI	R\$ -	50.000.000,00		R\$ 48.202.548,53	-R\$ 1.797.451,47	-3,59%
702-5	Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	R\$ 75.332.932,05			R\$ 77.858.186,06	R\$ 2.525.254,01	3,35%
702-5	Caixa FIA Infraestrutura	R\$ 18.475.888,38			R\$ 18.810.900,08	R\$ 335.011,70	1,81%
702-5	Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	R\$ 92.305.652,11			R\$ 92.870.872,49	R\$ 565.220,38	0,61%
	Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	R\$ 2.695.859,49			R\$ 2.686.896,23	-R\$ 8.963,26	-0,33%
29.921.251	Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	R\$ 22.631.267,32			R\$ 22.944.124,44	R\$ 312.857,12	1,38%
	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	R\$ 47.724.754,87			R\$ 48.199.324,17	R\$ 474.569,30	0,99%
73.339-3	Itau Asgard Institucional Acoes FI	R\$ 25.814.049,03			R\$ 26.909.936,98	R\$ 1.095.887,95	4,25%
	Santander Global Equities Dólar Master Mult Ie FI	R\$ -	50.000.000,00		R\$ 48.255.268,52	-R\$ 1.744.731,48	-3,49%
TOTAL RENDA VARIÁVEL		R\$ 509.227.405,43	R\$ 100.000.000,00	R\$ -	R\$ 615.841.459,16	R\$ 6.614.053,73	1,18%
RENTABILIDADE FINANCEIRA DO REGIME CAPITALIZADO		R\$ 3.021.910.587,07	R\$ 2.275.561.697,61	R\$ 2.259.185.074,20	R\$ 3.068.126.853,32	R\$ 29.839.642,84	0,98%
Conta	IMÓVEL	Saldo Atual	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
702-5	IMÓVEL - ESTACIONAMENTO	R\$ 8.200.000,00			R\$ 8.200.000,00	R\$ -	0,00%
RENTABILIDADE TOTAL DO REGIME CAPITALIZADO		R\$ 3.030.110.587,07	R\$ 2.275.561.697,61	R\$ 2.259.185.074,20	R\$ 3.076.326.853,32	R\$ 29.839.642,84	0,98%

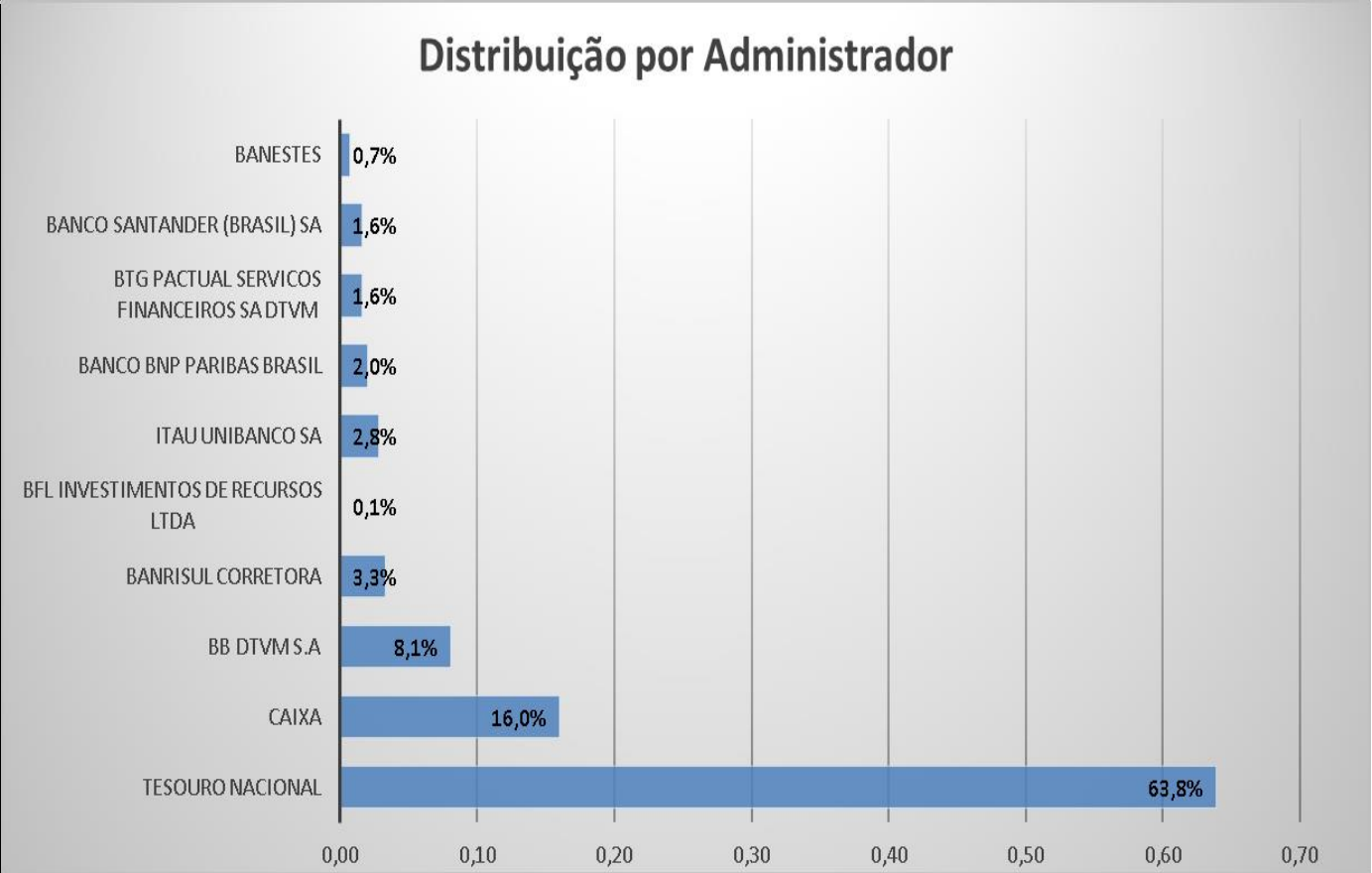


Movimentações: Outras Contas

Conta	Taxa de Administração e Repartição Simples	Saldo Atual	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
73.342-3	COMPREV - BB Prev RF IRFM-1	R\$ 970.129,11			R\$ 972.484,39	R\$ 2.355,28	0,24%
73.342-3	COMPREV - BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 2.346.188,36			R\$ 2.365.893,54	R\$ 19.705,18	0,84%
73.342-3	COMPREV - BB Previd RF Fluxo	R\$ 2.524.800,46	R\$ 1.061.811,47		R\$ 3.590.205,05	R\$ 3.593,12	0,12%
73.334-2	FUNDO PREVIDENCIA - BB Previd RF Fluxo	R\$ 136.782,90	R\$ 13.484,18	R\$ 1.265,19	R\$ 149.158,66	R\$ 156,77	0,11%
703-3	REPARTIÇÃO SIMPLES - Caixa Disponibilidades RF	R\$ 12.019.436,66	R\$ 4.075.932,07	R\$ 4.250.067,02	R\$ 11.861.245,08	R\$ 15.943,37	0,13%
704-1	TAXA ADM - Caixa IDKA2	R\$ 135.010,34			R\$ 136.385,63	R\$ 1.375,29	1,02%
704-1	TAXA ADM - Caixa IRFM-1		R\$ 68.370,00		R\$ 68.551,96	R\$ 181,96	0,27%
704-1	TAXA ADM - Caixa Disponibilidades	R\$ 794.125,11		R\$ 763.875,75	R\$ 30.724,57	R\$ 475,21	0,12%
73.360-1	TAXA ADM - BB Prev RF IRFM-1	R\$ 7.899.072,86			R\$ 7.918.250,24	R\$ 19.177,38	0,24%
73.360-1	TAXA ADM - BB Previd RF Fluxo	R\$ 10.417.900,26	R\$ 3.072.710,53	R\$ 739.577,91	R\$ 12.763.006,21	R\$ 11.973,33	0,10%
73.400-4	FRAP - BB Previd RF Fluxo	R\$ 929.845,18	R\$ 16.505,90		R\$ 947.373,33	R\$ 1.022,25	0,11%
420.000-4	ADIANTAMENTO - BB Previd RF Fluxo	R\$ 1.000,85		R\$ 739,90	R\$ 262,03	R\$ 1,08	0,17%
	Conta Corrente	R\$ 131.475,71			R\$ 75.801,34		0,00%
TOTAL TAXA ADM E REPARTIÇÃO SIMPLES		R\$ 38.305.767,80	R\$ 8.308.814,15	R\$ 5.755.525,77	R\$ 40.879.342,03	R\$ 20.285,85	0,05%
RENTABILIDADE CONSOLIDADA DO PREVIMPA		R\$ 3.068.416.354,87	R\$ 2.283.870.511,76	R\$ 2.264.940.599,97	R\$ 3.117.206.195,35	R\$ 29.859.928,69	0,97%

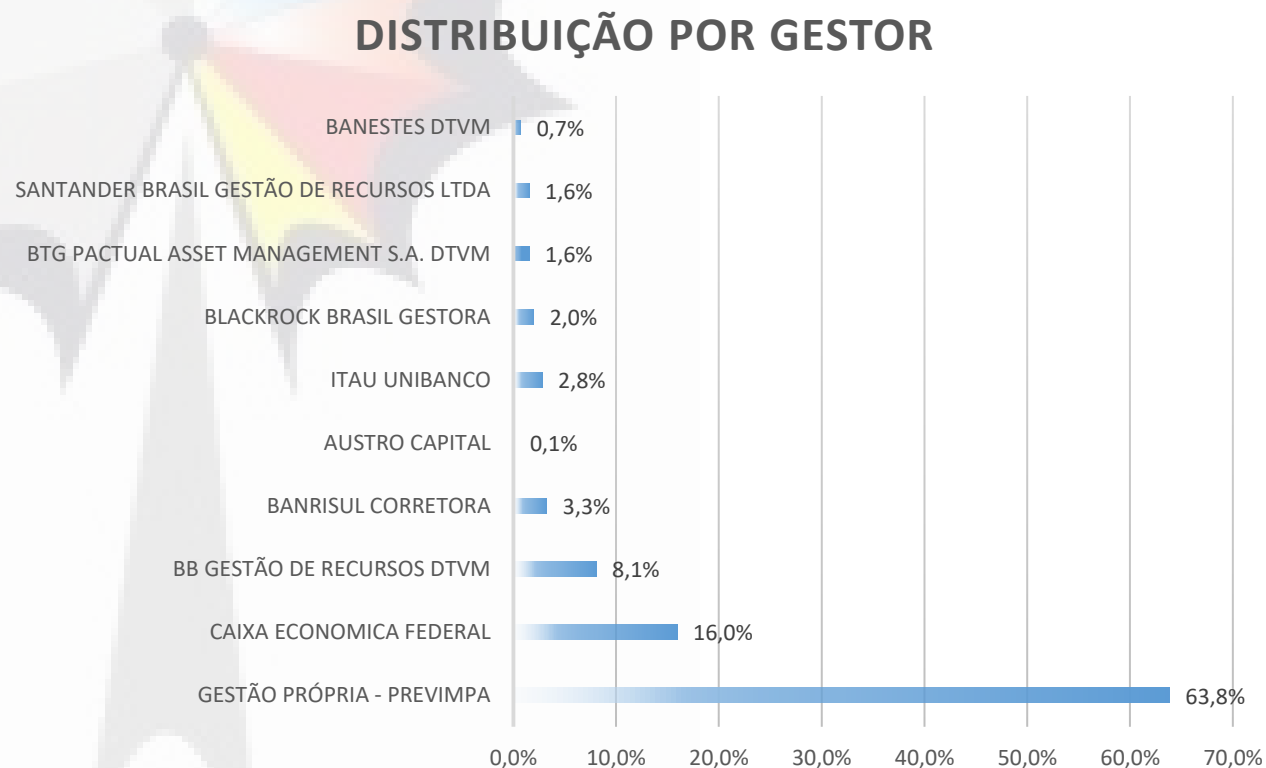
Distribuição por Administrador

Admistrador	Valor por Adm	Distribuição por Administrador
TESOURO NACIONAL	R\$ 1.958.997.946,57	63,8%
Caixa	R\$ 489.955.511,99	16,0%
BB Dtvn S.A	R\$ 247.875.264,05	8,1%
Banrisul Corretora	R\$ 100.762.580,37	3,3%
BFL INVESTIMENTOS DE RECURSOS LTDA	R\$ 2.686.896,23	0,1%
Itau Unibanco SA	R\$ 86.899.936,98	2,8%
Banco BNP Paribas Brasil	R\$ 61.550.000,00	2,0%
BTG Pactual Servicos Financeiros SA Dtvn	R\$ 48.199.324,17	1,6%
Banco Santander (Brasil) SA	R\$ 48.255.268,52	1,6%
Banestes	R\$ 22.944.124,44	0,7%



Distribuição por Gestor

Gestor	Valor por Gestor	Distribuição por Gestor
GESTÃO PRÓPRIA - PREVIMPA	1.958.997.946,57	63,8%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	489.955.511,99	16,0%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	247.875.264,05	8,1%
BANRISUL CORRETORA	100.762.580,37	3,3%
AUSTRO CAPITAL	2.686.896,23	0,1%
ITAU UNIBANCO	86.899.936,98	2,8%
BLACKROCK BRASIL GESTORA	61.550.000,00	2,0%
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S.A. D	48.199.324,17	1,6%
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS	48.255.268,52	1,6%
BANESTES DTVM	22.944.124,44	0,7%



Enquadramento Renda Fixa

Títulos públicos	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	Enquadramento resolução 3922	Limite do enquadramento 3922	Limite da política de investimentos	Alvo da política de investimentos	Valor por Carteira	% Alocado Carteira
Títulos da carteira Previmpa	1.958.997.946,57			Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a '	100%	100%	70%	1.958.997.946,57	63,85%

Renda fixa	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	Enquadramento resolução 3922	Limite do enquadramento 3922	Limite da política de investimentos	Alvo da política de investimentos	Valor por Carteira	% Carteira
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	281.274.082,83	11.053.033.773,31	2,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	100%	100%	6%	486.692.301,27	15,86%
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	17.196.239,45	13.787.568.837,50	0,12%						
BB Prev RF Idka 2 FI	87.460.646,13	9.007.156.922,34	0,97%						
Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	100.761.332,86	1.261.763.243,80	7,99%						
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	1.945.231,08	491.688.926,17	0,40%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a '	40%	40%	1%	6.595.146,32	0,21%
BB Prev RF Fluxo Fc FI	4.648.667,73	2.370.174.502,32	0,20%						
Banrisul Automatico FI RF CP	1.247,51	886.969.052,56	0,00%						

Enquadramento Renda Variável

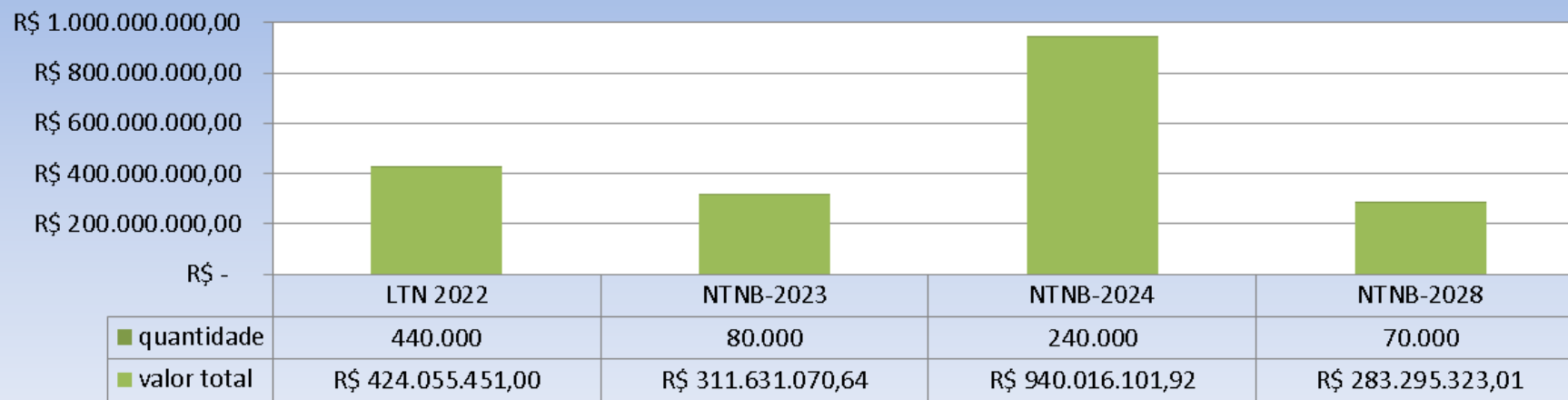
Renda Variável	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	Enquadramento resolução 3922	Limite do enquadramento 3922	Limite da política de investimentos	Alvo da política de investimentos	Valor por Carteira	% Carteira
It Now Ibov	59.990.000,00	7.519.759.737,54	0,80%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30%	30%	6%	121.540.000,00	3,96%
Ishares S&P 500	61.550.000,00	4.521.796.340,13	1,36%						
Caixa FIA Infraestrutura	18.810.900,08	505.735.143,75	3,72%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20%	20%	4%	304.972.769,62	9,94%
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	77.858.186,06	1.058.361.655,90	7,36%						
BB Acoes Retorno Total Fc	20.618.824,63	1.556.749.997,17	1,32%						
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	23.807.288,13	922.755.186,80	2,58%						
BB Acoes Exportacao Fc FI	15.026.800,87	271.990.812,87	5,52%						
BB Acoes Energia FI	48.110.488,03	452.829.023,29	10,62%						
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	48.199.324,17	2.879.178.885,72	1,67%						
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	22.944.124,44	238.974.809,93	9,60%						
Itau Asgard Institucional Acoes FI	26.909.936,98	398.235.843,70	6,76%						
Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	2.686.896,23	21.512.568,95	12,49%						
BB Acoes Nordea GI Cli And Env le FI	48.202.548,53	659.858.694,37	7,30%	Artigo 9º - A, Inciso II	10%			189.328.689,54	6,17%
Santander Global Equities Dólar Master M	48.255.268,52	2.066.683.720,60	2,33%						
Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	92.870.872,49	3.039.632.406,38	3,06%	Artigo 9º - A, Inciso III		10%	5%		

*Fundo Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA está com Desenquadramento Passivo, pois não atende o Artigo 15 Resolução 3922/2010.

Carteira de Títulos públicos

Cód. Papel	Vencimento	Data Compra	Qtde. Total	PU Compra	Preço Unitário	Taxa %	Valor Total à Mercado	Valor Total na Curva	%PL
Títulos Públicos									
LTN									
LTN20220101 - 100000	01/01/2022	21/03/2018	80.000	727,41891400	969,25177700	8,799000	77.540.142,16	75.550.505,36	3,96%
LTN20220101 - 100000	01/01/2022	09/04/2018	200.000	732,97834600	969,25177700	8,694000	193.850.355,40	189.000.054,40	9,90%
LTN20220401 - 100000	01/04/2022	07/02/2020	160.000	898,51867100	954,15595900	5,140000	152.664.953,44	152.754.230,08	7,79%
Total LTN:			440.000				424.055.451,00	417.304.789,84	21,65%
NTN-PÓS									
NTNB20230515 - 760199	15/05/2023	14/04/2021	80.000	3.860,87637900	3.895,38838300	2,259018	311.631.070,64	309.728.323,12	15,91%
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	17/12/2020	40.000	3.987,99033100	3.916,73375800	1,629008	156.669.350,32	161.802.235,48	8,00%
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	14/04/2021	160.000	3.836,63293600	3.916,73375800	3,315875	626.677.401,28	615.843.734,88	31,99%
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	29/04/2021	40.000	3.916,92915700	3.916,73375800	2,709981	156.669.350,32	156.715.384,52	8,00%
NTNB20280815 - 760199	15/08/2028	06/06/2019	20.000	3.820,89142600	4.047,07604300	3,819000	80.941.520,86	80.343.976,50	4,13%
NTNB20280815 - 760199	15/08/2028	06/06/2019	20.000	3.820,89142600	4.047,07604300	3,819000	80.941.520,86	80.343.976,50	4,13%
NTNB20280815 - 760199	15/08/2028	06/06/2019	30.000	3.820,89142600	4.047,07604300	3,819000	121.412.281,29	120.515.964,75	6,20%
Total NTN-PÓS:			390.000				1.534.942.495,57	1.525.293.595,75	78,35%
Total Títulos Públicos:			830.000				R\$ 1.958.997.946,57	R\$ 1.942.598.385,59	100,0%

Distribuição dos Títulos Públicos em Carteira



Duration de MACAULAY (anos)	Duration Modificada	Variação % Preço (100 PB)	Variação em MOEDA (100 PB)	Variação em MOEDA (1 PB)	Duration do Passivo Atuarial
2,79	2,71	2,71%	-R\$ 53.035.004,47	-R\$ 5.303,50	20,94 anos

Conceitos de Avaliação de Risco

AVALIAÇÃO DE RISCO – Busca avaliar a probabilidade do impacto dos riscos.

VAR 95% - estima a perda potencial máxima de um investimento em 1 mês, com 95% de grau de confiança.

Volatilidade - Mede a variação do retorno do fundo em relação à sua média.

Sortino - Considera apenas a volatilidade negativa como fator de risco.

Se o resultado for acima de 100% significa que para cada 1,00% de risco adicionado à carteira, houve 1,00% ou mais de rendimento obtido em relação à taxa livre de risco.

Se o resultado for abaixo de 100% significa que para cada 1,00% de risco adicionado à carteira, houve 1,00% ou menos de rendimento obtido em relação à taxa livre de risco.

Sharpe - Mede o retorno excedente de uma aplicação financeira em relação a outra aplicação livre de risco(CDI).

Beta - Representa a volatilidade média com relação ao seu benchmark, Se $B > 1$ a carteira oscila mais (mais arriscada)

Rentabilidade e Risco Renda Fixa

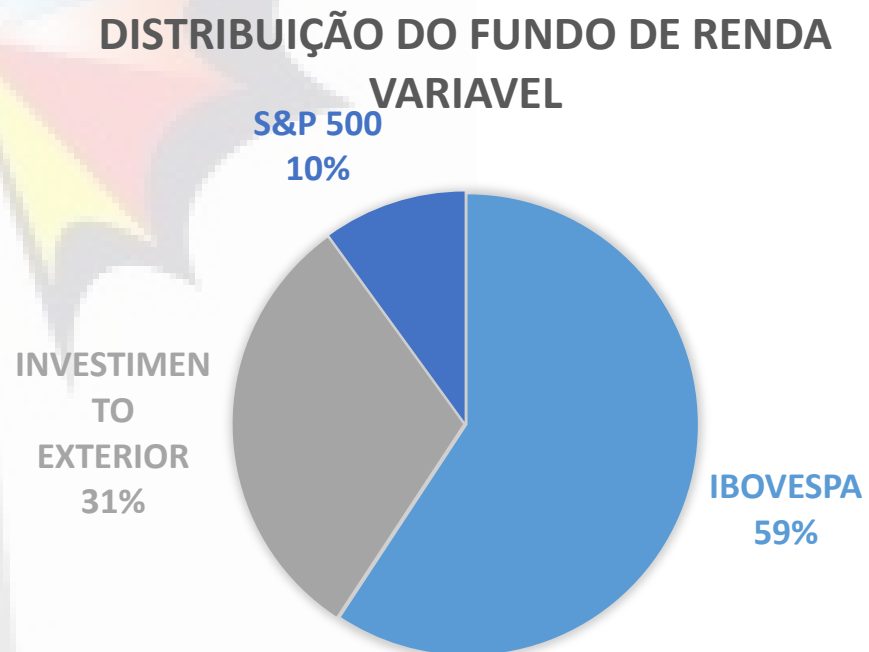
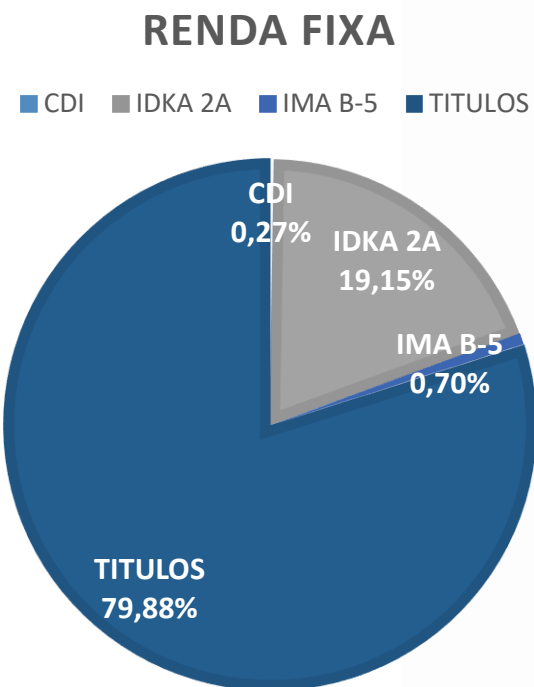
Títulos Públicos	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	No ano
BENCHMARK IMA EX-G	0,49	-0,72	1,64	3,81	12,47	-1,16
Títulos Públicos da carteira Previmpa	0,95	-2,1270	0,5666	2,9300	15,7293	-3,3375

Fundos de Renda fixa	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	No ano	VaR 95% 1 M	Volatilid ade	Sortino 12M	Sharpe 12M	Beta 12M
BENCHMARK CDI	0,21	0,54	1,01	2,14	7,45	0,69					
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	0,14	0,34	0,59	1,30	5,66	0,42	0,00%	0,03%	-1607,36%	-163,48	0,00
BB Prev RF Fluxo Fc FI	0,11	0,26	0,50	1,02	5,13	0,34	0,00%	0,15%	-929,46%	-7,70	0,00
Banrisul Automatico FI RF CP	0,08	0,15	0,21	0,34	1,22	0,17	0,00%	0,02%	-1581,55%	-86,99	0,00
BENCHMARK IMA B 5	0,87	0,62	3,92	8,92	18,36	0,72					
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	0,86	0,55	3,78	8,62	17,71	0,63	0,29%	2,49%	412,02%	2,58	0,10
BENCHMARK IDKA 2A	1,35	1,16	4,35	9,41	18,84	1,30					
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	1,02	0,86	3,91	9,09	17,10	0,99	0,30%	2,36%	459,92%	2,92	0,08
BB Prev RF Idka 2 FI	0,84	0,66	3,75	9,19	16,78	0,84	0,29%	2,25%	503,82%	3,11	0,08
Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	0,89	0,61	3,55	8,36	16,57	0,69	0,29%	2,32%	416,94%	2,66	0,08

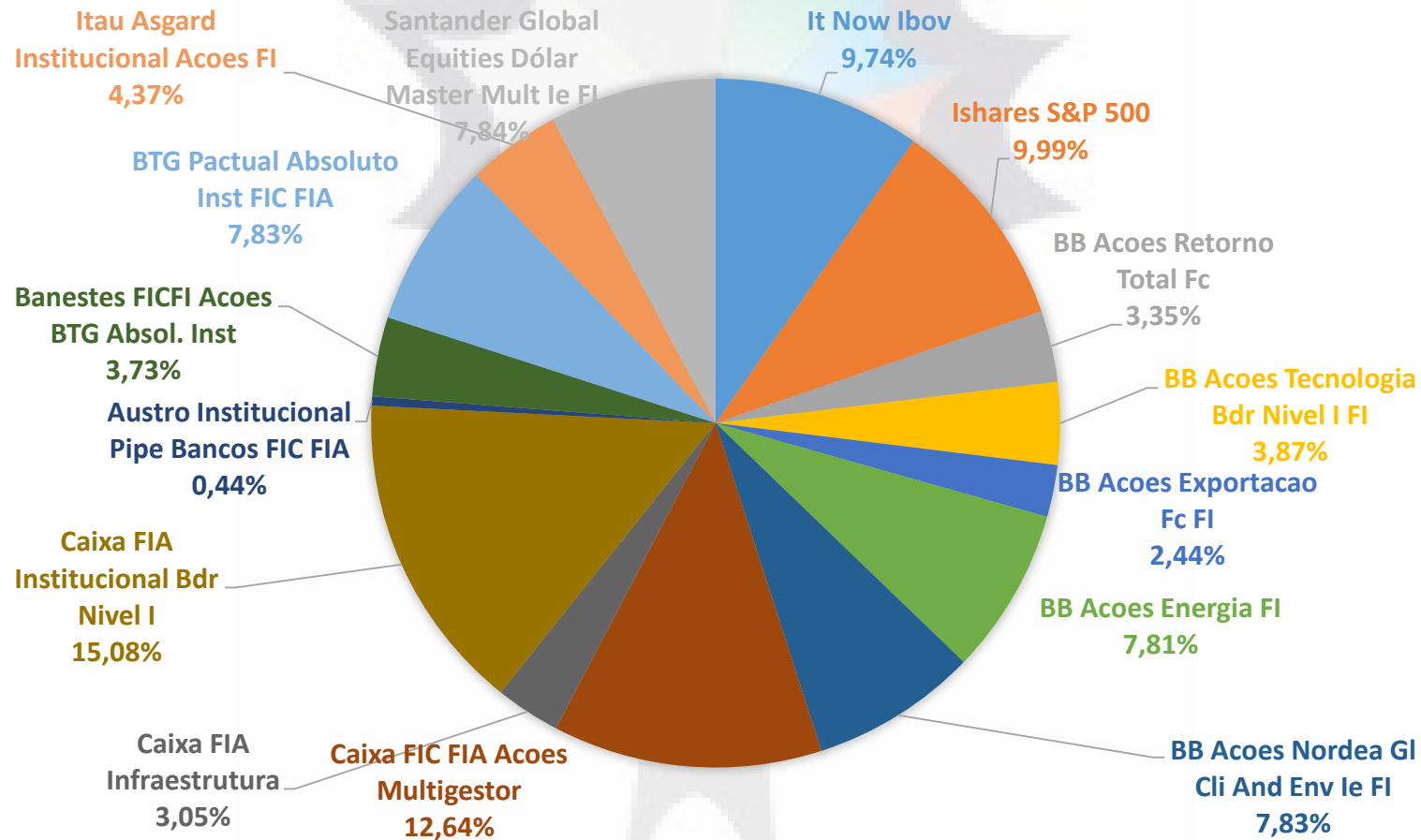
Rentabilidade e Risco Renda Variável

Fundos Renda Variável	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	No ano	VaR 95% 1M	Volatilid ade 12M	Sortino 12M	Sharpe	Beta 12M
BENCHMARK IBOVESPA	1,94	3,33	26,55	47,68	23,39	-0,10					
Caixa FIA Infraestrutura	1,81	2,47	21,54	40,63	34,86	-1,75	1,20%	25,08%	262,19%	1,69	1,02
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	3,35	3,67	22,34	41,63	N.A.	1,00	0,99%	21,37%	308,96%	1,97	0,89
BB Acoes Retorno Total Fc	7,96	14,04	33,19	49,24	42,36	10,42	1,21%	21,42%	353,89%	2,33	0,80
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	5,67	4,82	24,28	45,63	80,08	10,47	1,34%	19,80%	337,88%	2,32	0,24
BB Acoes Exportacao Fc FI	6,93	19,40	43,64	76,04	63,99	18,30	1,44%	20,88%	598,51%	3,68	0,49
BB Acoes Energia FI	-1,75	0,15	13,29	24,06	21,78	-4,95	1,32%	21,94%	176,99%	1,12	0,93
Itau Asgard Institucional Acoes FI	4,41	-0,61	20,87	N.A	N.A	1,26	1,22%	N.A	N.A	N.A	N.A
Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	-0,33	-7,00	-20,23	-53,03	-70,70	-21,61	1,54%	33,95%	-194,07%	-1,53	-0,05
It Now Ibov	1,92	3,34	26,39	47,68	23,22	-0,21	1,44%	24,07%	319,63%	2,08	1,01
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	0,99	0,14	13,82	42,42	38,03	-0,48	1,42%	22,12%	310,01%	1,95	0,68
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	0,99	0,13	13,72	42,21	37,82	-0,48	1,42%	22,03%	309,42%	1,95	0,67
BENCHMARK BDR	0,98	8,17	18,81	43,53	100,22	14,79					
BB Acoes Nordea GI Cli And Env le FI	0,36	8,35	24,11	61,23	118,58	14,91	1,76%	25,32%	420,06%	2,50	0,03
Santander Global Equities Dólar Master M	1,05	8,42	20,09	47,48	102,37	14,53	1,53%	20,78%	372,76%	2,30	-0,09
Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	0,61	7,75	17,57	42,44	98,93	13,99	2,15%	22,78%	289,39%	1,91	-0,11
Ishares S&P 500	1,56	12,27	21,92	44,87	101,06	17,60	2,02%	22,65%	322,69%	2,05	-0,09

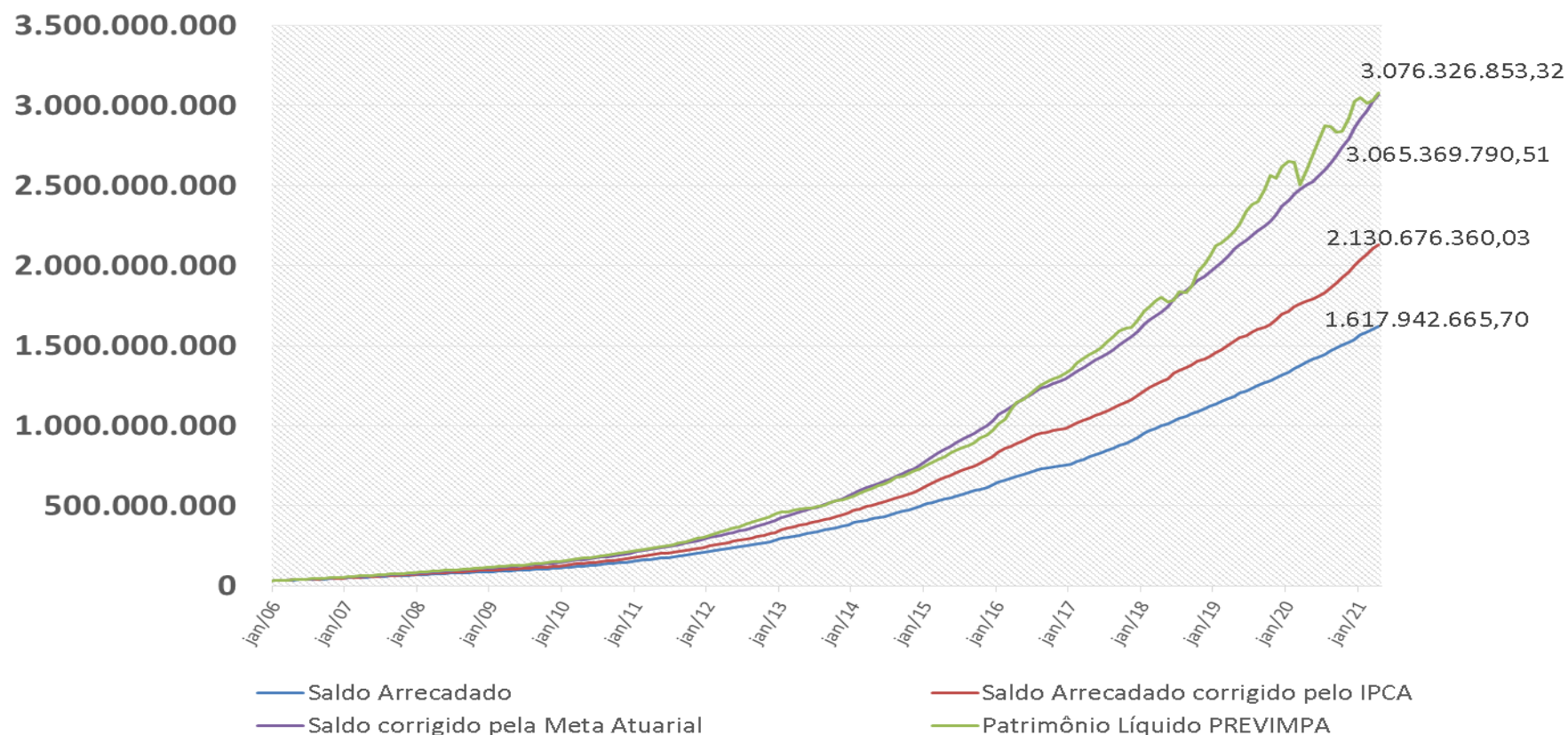
Distribuição dos Fundos por Benchmarck



Distribuição dos Fundos Renda Variável



Patrimônio Financeiro Líquido Regime Capitalizado (Janeiro de 2006 a Abril de 2021)



Informação dos fundos

Administrador	Gestor	Custodiante	Nome do fundo	CNPJ do fundo	Taxa de Adm % a.a.	Taxa de Performance % a.a.	Liquidação Financeira - Aplicação	Liquidação Financeira - Resgate	Carência	Horário Limite - Aplicação/ Resgate
Renda Fixa										
Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Brasil Disponibilidades RF	14.508.643/0001-55	0,80%	Não há	D+0	D+0	Não há	18:00
			Caixa IMAB 5 RF LP	11.060.913/0001-10	0,20%	Não há	D+0	D+0	Não há	16:00
			Caixa IRFM-1 RF LP	10.740.670/0001-06	0,20%	Não há	D+0	D+0	Não há	17:00
			Caixa IDKA IPCA RF LP	14.386.926/0001-71	0,20%	Não há	D+0	D+0	Não há	16:00
BB Gestão de Recursos DTVM	BB Gestão de Recursos DTVM	Banco do Brasil	BB RPPS RF Fluxo	13.077.415/0001-05	1,00%	Não há	D+0 Abertura	D+0	Não há	23:00
			BB PREV IRFM-1	11.328.882/0001-35	0,30%	Não há	D+0	D+0	Não há	15:00
			BB PREV IDKA 2A	13.322.205/0001-35	0,20%	Não há	D+0	D+1	Não há	15:00
Banco do Estado do Rio Grande do Sul	Banrisul Corretora	Banrisul Corretora	Banrisul Foco IDKA 2A	21.007.180/0001-03	0,20%	Não há	D+0	D+1	Não há	15:00
			Banrisul Automático FI RF CP	01.353.260/0001-03	1,60%	Não há	D+0	D+0	Não há	17:30
Renda Variável										
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	Caixa Institucional BDR I	17.502.937/0001-68	0,70%	Não há	D+1	D+1	Não há	17:00
			Caixa FI Ações Infraestrutura	10.551.382/0001-03	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
			Caixa FIC FIA Ações Multigestor	30.068.224/0001-04	1,50%	Não há	D+1	D+3	Não há	13:00
BB Gestão de Recursos DTVM	BB Gestão de Recursos DTVM	Banco do Brasil	BB Ações Retorno Total	09.005.805/0001-00	1,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
			BB Acoes Exportacao Fc FI	05.100.213/0001-09	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
			BB Acoes Energia FI	02.020.528/0001-58	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
			BB ações Nordea FI	28.578.936/0001-13	1,15%	Não há	D+1	D+5	Não há	17:00
			BB Ações Tecnologia	01.578.474/0001-88	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
ITAÚ UNIBANCO S.A.	ITAÚ UNIBANCO S.A.	ITAÚ UNIBANCO S.A.	Itaú Ações Asgard Instit. FICFIA	35.495.250/0001-24	2,00%	Não há	D+0	D+23	Não há	16:00
BFL INVESTIMENTOS DE RECURSOS LTDA	Austro Capital	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	Austro Pipe Bancos	28.319.463/0001-30	0,40%	6,00% do que exceder (IPCA + 6,00% a.a.)	D+1	D+30	30/04/2021	13:00
ITAÚ UNIBANCO S.A.	ITAÚ UNIBANCO S.A.	Banrisul Corretora	ETF BOVV 11	21.407.758/0001-19	0,30%	Não há	D+2	D+2	Não há	17:00
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S.A.	BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM	Banco BTG PACTUAL	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	11.977.794/0001-64	3,00%	Não há	D+1	D+32	Não há	15:30
BNB Paribas	Black Rock	Banrisul Corretora	ETF IVVB 11	19.909.560/0001-91	0,24%	Não há	D+2	D+2	Não há	17:00
BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS	SANTANDER CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA	Santander Global Equities Dolar	17.804.792/0001-50	1,00%	Não há	D+1	D+8	Não há	12:00
BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO SANTO	BANESTES DTVM SA	BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO SANTO	Banestes BTG Absoluto FIC FIA	08.018.849/0001-02	3,00%	Não há	D+1	D+30	Não há	15:00